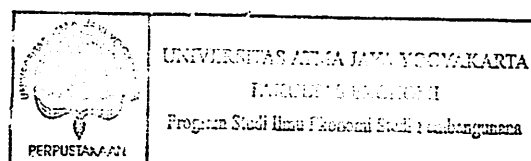


INFLATION (ECONOMICS)

	UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA FACULTY OF ECONOMICS
20 MAR 2007	
226/ESP/Hd.3/2007	
Rf 332.41 Ind 07	



**HUBUNGAN KAUSALITAS
ANTARA JUMLAH UANG BEREDAR DENGAN LAJU
INFLASI**

Studi Kasus di Indonesia Tahun 1998Q1-2005Q4

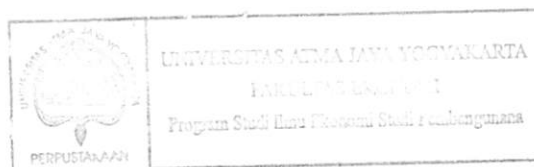
SKRIPSI

**Untuk Memenuhi Sebagian Persyaratan Mencapai Derajat Sarjana Ekonomi (S1)
Pada Program Studi Ilmu Ekonomi dan Studi Pembangunan
Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta**



Disusun oleh :
Andy Wongso
NPM : 02 11 13727

**FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ATMA JAYA YOGYAKARTA
Maret, 2007**



SKRIPSI

HUBUNGAN KAUSALITAS

ANTARA JUMLAH UANG BEREDAR DENGAN LAJU

INFLASI

Studi Kasus di Indonesia Tahun 1998Q1-2005Q4

Disusun oleh:
Andy Wongso
NPM: 02 11 13727

Telah dibaca dan disetujui oleh:

Pembimbing Utama

Kuspradono

Kuspradono, Dipl-Volksw.

Tanggal 13 Februari 2007

SKRIPSI
HUBUNGAN KAUSALITAS
ANTARA JUMLAH UANG BEREDAR DENGAN LAJU
INFLASI

Studi Kasus di Indonesia Tahun 1998Q1-2005Q4

Yang dipersiapkan dan disusun oleh:

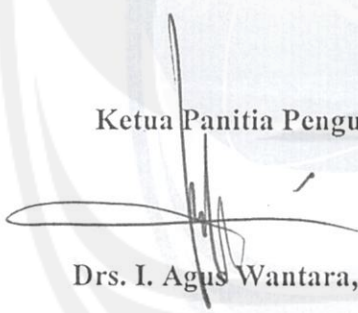
Andy Wongso

NPM: 02 11 13727

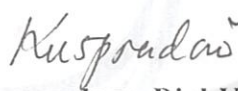
Telah dipertahankan di depan panitia penguji pada tanggal 2 Maret 2007 dan dinyatakan telah memenuhi persyaratan untuk mencapai derajat Sarjana Ekonomi (S1) pada Program Studi Ilmu Ekonomi dan Studi Pembangunan Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta

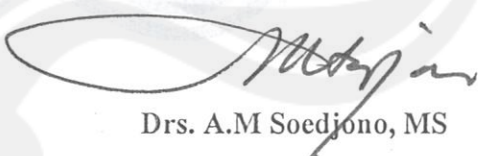
SUSUNAN PANITIA PENGUJI

Ketua Panitia Penguji


Drs. I. Agus Wantara, M.Si.

Anggota Panitia Penguji


Kuspradono, Dipl-Volksw.


Drs. A.M Soedjono, MS

Yogyakarta, 2 Maret 2007

Dekan Fakultas Ekonomi

Universitas Atma Jaya Yogyakarta


Dr. R. Maryatmo, MA.


FAKULTAS
EKONOMI

PERNYATAAN

Saya yang bertanda tangan di bawah ini dengan sesungguhnya menyatakan bahwa skripsi dengan judul:

HUBUNGAN KAUSALITAS ANTARA JUMLAH UANG BEREDAR DENGAN LAJU INFLASI

Studi Kasus di Indonesia Tahun 1998Q1-2005Q4

Benar-benar hasil karya saya sendiri. Pernyataan, ide, maupun kutipan baik langsung maupun tidak langsung yang bersumber dari tulisan atau ide orang lain dinyatakan secara tertulis dalam skripsi ini dalam catatan perut / daftar pustaka. Apabila di kemudian hari terbukti bahwa saya melakukan plagiasi sebagian atau seluruhnya dari skripsi ini, maka gelar dan ijazah yang saya peroleh dinyatakan batal dan akan saya kembalikan kepada Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Yogyakarta, 21 November 2006

Yang menyatakan,



Andy Wongso

KATA PENGANTAR

Puji dan syukur saya panjatkan kepada Tuhan Yang Maha Esa atas berkat, kasih, dan setia-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan penulisan skripsi yang berjudul HUBUNGAN ANTARA JUMLAH UANG BEREDAR DENGAN INFLASI, studi kasus di Indonesia tahun 1998Q1-2005Q4.

Adapun tujuan dari skripsi ini adalah untuk memenuhi salah satu syarat mencapai derajat sarjana S-1 pada Fakultas Ekonomi Jurusan Ilmu Ekonomi dan Studi Pembangunan di Universitas Atma Jaya Yogyakarta.

Penulis menyadari bahwa dalam pembuatan skripsi ini terdapat banyak kekurangan dan jauh dari sempurna karena terbatasnya kemampuan penulis. Oleh karena itu penulis mengharapkan kritik dan saran demi tersempurnanya skripsi ini.

Pada kesempatan ini penulis juga ingin menyampaikan ucapan terima kasih yang sebesar-besarnya atas segala bantuan, bimbingan, serta pelayanan yang telah diberikan dengan segala ketulusan kepada penulis sampai terselesaikan skripsi ini kepada :

1. Kepada Tuhan Yesus Kristus. Terima kasih atas semua berkat-Nya.
2. Bapak DR. R. Maryatmo, MA. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta.
3. Ibu AM. Rini Setyastuti, SE., M.Si. selaku ketua program studi Ilmu Ekonomi Fakultas Ekonomi Universitas Atma Jaya Yogyakarta. Terima kasih atas dukungannya.

4. Bapak Kuspradono, Dipl-Volksw. selaku Dosen Pembimbing Utama yang telah mengorbankan waktu, pikiran dan tenaga memberikan bimbingan dan mengarahkan penulisan dalam penyusunan skripsi ini sampai selesai.
5. Orang tua di rumah, kakak, dan abang serta saudara-saudara yang sudah mendukung saya baik secara material maupun semangat dalam menyelesaikan studi S1 di Universitas Atma Jaya Yogyakarta.
6. Semua dosen, karyawan TU, dan karyawan perpustakaan SI dan S2 Universitas Atma Jaya Yogyakarta yang telah membantu penulis dalam menyusun skripsi ini
7. Teman-teman yang telah mendukung saya : Benny, SE., Indra, SE., Yudhi, SE., Seno, Eko, Lin, Shinta, Yunus, Ajeng, dan teman-teman seperjuangan dalam menyelesaikan skripsinya Juven, Silvi, Nina. Terima kasih atas bantuannya selama ini.
8. Teman-teman saya yang di kontrakan (Irawan, Bone, Tony, Ricky, Joe, Stephen, Abie, Andri, Chris, Ches, dan Victor) terima kasih atas kebersamaannya dan fasilitasnya khususnya komputernya sehingga bisa ditulis skripsi ini dengan susah payah.
9. Teman-teman seperjuangan : Yoyok, Debo, Yuven, teman-teman kelas H (Yuli, Devi, Uli).
10. Saudara saya yang di malang, Bapak Frans Widjaja, terima kasih sudah memberikan pengarahan dan pendidikan dalam menyelesaikan skripsi ini.
11. Teman-teman di gereja Keluarga Allah (Mikel, Yudis, Hadi, Cecep) terima kasih atas dukungan spiritualnya. Tuhan memberkati kalian juga.

12. Teman-teman KKN kelompok 24 Panggang (Edo, Rio, Yokky, dan teman dari kelompok-kelompok lain). Terima kasih atas kerja samanya.
13. Semua orang yang tidak dapat penulis sebutkan satu persatu yang telah sangat membantu penulis dalam menyusun skripsi ini.

Akhir kata penulis mengucapkan banyak terima kasih yang sebesar-besarnya kepada pembaca budiman. Semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi semua pihak.

Yogyakarta, 21 November 2006

Andy Wongso

PERSEMBAHAN

For the love of God

Motto

Ujian bagi seseorang yang sukses bukanlah pada kemampuannya untuk mencegah munculnya masalah, tetapi pada waktu menghadapi dan menyelesaikan setiap kesulitan saat masalah itu terjadi. (*David J. Schwartz*)

“Dengan ilmu, kehidupan menjadi mudah.

Dengan seni, kehidupan menjadi indah.

Dengan agama, hidup menjadi terarah dan bermakna.”

H.A. Mukti Ali

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
INTISARI.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	4
1.3. Tujuan Penelitian.....	5
1.4. Manfaat Penelitian.....	5
1.5. Studi Terkait.....	6
1.6. Hipotesa Penelitian.....	6
1.7. Metode Penelitian.....	7
1.7.1. Jenis dan Sumber Data.....	7
1.7.2. Definisi Operasional.....	7

	Halaman
1.7.3. Metode Analisis Data.....	7
1.7.3.1. Uji Kausalitas Model Granger	
dengan menggunakan FPE.....	7
1.7.3.2. Uji F.....	11
1.8. Sistematika Penulisan.....	13
BAB II LANDASAN TEORI.....	14
2.1. Definisi dan Fungsi Uang.....	14
2.2. Teori Permintaan Uang Klasik.....	17
2.3. Arti penting uang dalam perekonomian.....	18
2.3.1. Produksi.....	18
2.3.2. Pertukaran dan Konsumsi.....	19
2.4. Pengertian Inflasi.....	19
2.5. Jenis-jenis Inflasi.....	19
2.5.1. Inflasi menurut sifatnya.....	19
2.5.2. Inflasi menurut sebabnya.....	20
2.6. Teori Kuantitas.....	25
2.7. Hubungan jumlah uang beredar dengan laju inflasi.....	26
BAB III GAMBARAN UMUM LAJU INFLASI	
DAN JUMLAH UANG BEREDAR 1998Q1-2005Q4.....	28
3.1. Perkembangan laju inflasi di Indonesia.....	28
3.2. Perkembangan jumlah uang beredar di Indonesia.....	30

	Halaman
BAB IV ANALISIS DATA.....	34
4.1. Uji Kausalitas Model Granger dengan penentuan Lag Optimum menggunakan FPE.....	34
4.2. Uji F.....	38
4.3. Intepretasi Ekonomi.....	39
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	41
5.1. Kesimpulan.....	41
5.2. Saran.....	42
DAFTAR PUSTAKA.....	44
LAMPIRAN.....	45

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Perkembangan laju inflasi dan pertumbuhan jumlah uang beredar tahun 1995-2002.....	2
Tabel 3.1 Laju inflasi di Indonesia 1998Q1-2005Q4.....	29
Tabel 3.2 Jumlah uang beredar di Indonesia 1998Q1-2005Q4.....	31
Tabel 4.1 Nilai FPE (m,0) untuk laju inflasi (Y) dan jumlah uang beredar (X) di Indonesia 1998Q1-2005Q4.....	35
Tabel 4.2 Nilai FPE (m,n) untuk laju inflasi (Y) dan jumlah uang beredar (X) di Indonesia 1998Q1-2005Q4.....	36
Tabel 4.3 Lag optimal untuk manipulated variable dan FPE untuk controlled variable.....	37
Tabel 4.4 Hasil regresi uji kausalitas Granger dengan menggunakan metode FPE optimal laju inflasi dan jumlah uang beredar.....	38
Tabel 4.5 Perhitungan Uji F untuk persamaan 4.1 dan persamaan 4.2.....	39

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Inflationary Gap.....	21
Gambar 2.2 Demand Pull Inflation.....	22
Gambar 2.3 Cost Push Inflation.....	24
Gambar 3.1 Perkembangan Laju Inflasi di Indonesia 1998Q1-2005Q4.....	33
Gambar 3.2 Perkembangan Jumlah Uang Beredar di Indonesia 1998Q1-2005Q4.....	33

DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 : Data Laju inflasi dan jumlah uang beredar 1998Q ₁ -2005Q ₄	46
Lampiran 2 : Hasil regresi untuk variabel laju inflasi dalam proses Autoregresif satu dimensi.....	47
Lampiran 3 : Hasil regresi untuk variabel jumlah uang beredar (X) dalam proses Autoregresif Satu Dimensi.....	53
Lampiran 4 : Hasil regresi variabel laju inflasi (Y) terhadap variabel jumlah uang beredar (X) untuk menghitung nilai FPE (m,n)....	59
Lampiran 5 : Hasil regresi variabel jumlah uang beredar (X) terhadap variabel laju inflasi (Y) untuk menghitung nilai FPE (m,n).....	68
Lampiran 6 : Hasil regresi persamaan 4.1 Uji Kausalitas Granger dengan menggunakan FPE kriteria.....	76
Lampiran 7 : Hasil regresi persamaan 4.2 Uji Kausalitas Granger dengan menggunakan FPE kriteria.....	77
Lampiran 8 : Perhitungan Nilai FPE (m,0) untuk variabel laju inflasi (Y).....	78
Lampiran 9 : Perhitungan Nilai FPE (m,0) untuk variabel jumlah uang beredar (X).....	79
Lampiran 10 : Perhitungan Nilai FPE (m,n) untuk variabel laju inflasi (Y)....	80
Lampiran 11 : Perhitungan Nilai FPE (m,n) untuk variabel jumlah uang beredar (X).....	81
Lampiran 12 : Perhitungan Uji F.....	82

HUBUNGAN KAUSALITAS ANTARA JUMLAH UANG BEREDAR DENGAN LAJU INFLASI

Studi Kasus di Indonesia Tahun 1998Q1-2005Q4

Disusun oleh :

Andy Wongso

NPM : 02 11 13727

Pembimbing

Kuspradono, Dipl-Volksw.

INTISARI

Skripsi ini bermaksud mengkaji hubungan kausalitas antara laju inflasi dengan jumlah uang beredar selama periode 1998Q1-2005Q4 dengan menggunakan Uji Kausalitas *Granger* (1969) yang dipadukan dengan metode *Final Prediction Error* (FPE) untuk menentukan jumlah *lag* yang optimal dan Uji F untuk memperkuat hipotesis penelitian ini.

Uji Kausalitas *Granger* dilakukan untuk mengetahui apakah terjadi hubungan kausalitas antara laju inflasi dengan jumlah uang beredar di Indonesia. Selain itu, Uji Kausalitas *Granger* dilakukan untuk mengetahui bagaimana pola / arah hubungan kausalitas antara laju inflasi dengan jumlah uang beredar di Indonesia.

Berkaitan dengan Uji Kausalitas *Granger* di atas, dapat dikemukakan bahwa laju inflasi mempengaruhi jumlah uang beredar dan sebaliknya jumlah uang beredar mempengaruhi laju inflasi, sehingga terjadi saling mempengaruhi antara laju inflasi dan jumlah uang beredar.

Kata kunci : Laju inflasi, dan jumlah uang beredar